



CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2023



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SÃO BERNARDO DO CAMPO - SBCPREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2023

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			491.491,340,24	31,54%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	65.991,211,49	4,24%	661	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.216,420,65	0,78%	766	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.835,868,26	1,02%	473	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.080,634,29	2,06%	794	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	37.654,108,46	2,42%	920	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.512,385,08	0,87%	293	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	32.660,142,86	2,10%	23	9,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	73.815,239,73	4,74%	124	7,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	41.038,498,85	2,63%	122	6,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	13.291,691,85	0,85%	18	3,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.570,584,78	0,23%	4.434	2,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.197,029,61	0,98%	203	2,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	36.008,536,06	2,31%	144	3,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.424,434,29	1,37%	81	6,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	16.564,001,49	1,06%	228	1,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.617,645,33	0,68%	211	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.746,380,49	0,18%	1.377	2,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	15.380,569,50	0,99%	14	11,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	27.468,873,50	1,76%	465	0,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	D+45 a ...	01/08/2016	10.597.671,37	0,68%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	78.388,21	0,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	30.039,815,76	1,93%	14	5,76%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.476.650,14	0,61%	4.109	3,72%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	37.751,843,81	2,42%	3.383	3,21%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	8.231,695,61	0,53%	39	0,70%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	8.642,919,93	0,55%	5.168	2,42%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.580.694,64	0,10%	2.801	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÃO...	D+33	Não há	14.029,168,55	0,90%	162	1,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	29.971,731,63	1,92%	124	4,98%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.420,228,38	0,86%	215	5,96%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	27.397,922,04	1,76%	19.369	1,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.013,725,29	0,39%	43	1,21%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.123,241,85	1,29%	86	4,78%	Artigo 8º, Inciso I
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	20.102,250,74	1,29%	5.404	1,79%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	12.509,964,99	0,80%	1.566	1,46%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	17.570,975,04	1,13%	48	1,54%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	3.452,511,87	0,22%	37	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.532,976,26	0,93%	3.187	5,37%	Artigo 8º, Inciso I



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.195.922,38	1,30%	74	1,74%	Artigo 9º, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	13.000.884,24	0,83%	2	1,12%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.187.232,29	0,27%	1.904	5,14%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	14.859.028,92	0,95%	6.113	1,74%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	5.356.426,65	0,34%	241	1,84%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO ...	D+8 du	Não há	10.144.309,07	0,65%	2.190	5,39%	Artigo 9º, Inciso II
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+8 du	Não há	9.728.374,65	0,62%	561	0,44%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	23.165.452,64	1,49%	4.364	11,22%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	41.643.382,72	2,67%	2.224	8,39%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	13.173.235,34	0,85%	83	12,97%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	5.038.589,49	0,32%	583	3,06%	Artigo 10º, Inciso I
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	12.262.424,67	0,79%	28	14,92%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	20.742.178,47	1,33%	21	9,71%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	13.159.875,73	0,84%	22	10,31%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	14.745.799,24	0,95%	20	8,92%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATA...	Não se ...	Não se aplica	572.887,89	0,04%	21	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	20.571.491,99	1,32%	98	0,81%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	113.067,50	0,01%	39	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	7.874.341,59	0,51%	37	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.074.398,99	0,13%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II



**CRÉDITO
& MERCADO**

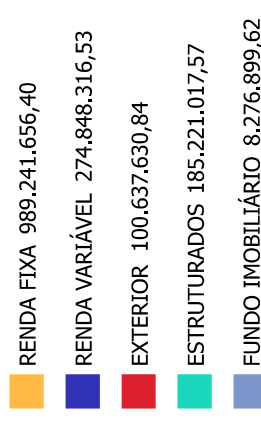
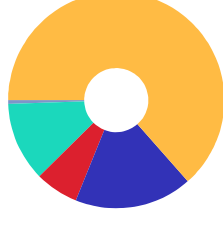
Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2023)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SÃO BERNARDO DO CAMPO - SBCPREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2023

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	20.758,989,06	1,33%		1,25%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FI...	Não se ...	Não há	394.733,86	0,03%	18	0,13%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTISTRATÉGIA...	Não se ...	Não se aplica	11.323.329,69	0,73%	46	3,88%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTISTRATÉGIA		Não há	772.291,34	0,05%		2,61%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	3.576.899,62	0,23%		5,83%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.700.000,00	0,30%		4,22%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		253.885,29	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.558.225.520,96				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			253.885,29				Artigo 6º
PL Total			1.558.479.406,25				



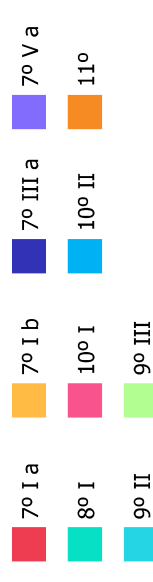
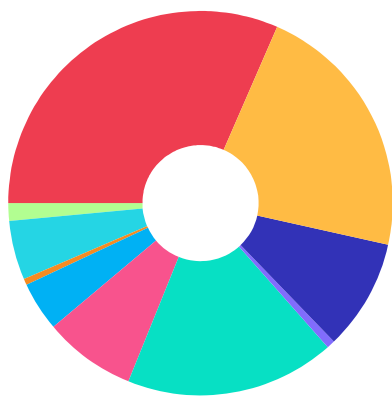
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	491.491.340,24	31,54%	17,00%	32,00%	100,00%	1.066.734.180,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	341.666.786,30	21,93%	10,00%	20,00%	100,00%	1.216.558.734,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.558.225.520,96
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	77.911.276,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	145.407.470,27	9,33%	1,00%	7,00%	60,00%	789.527.842,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	934.935.312,58
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	311.645.104,19
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	10.676.059,59	0,69%	0,00%	0,00%	5,00%	67.235.216,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	77.911.276,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	77.911.276,05
Total Renda Fixa	100,00%	989.241.656,40	63,49%	28,00%	59,00%	460,00%	



ⓘ ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2023)**

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	274.848.316,53	17,64%	6,00%	22,00%	35,00%	270.530.615,81
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	545.378.932,34
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	120.765.485,66	7,75%	1,00%	7,00%	10,00%	35.057.066,44
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	64.455.531,91	4,14%	1,00%	3,00%	5,00%	13.455.744,14
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	77.911.276,05
Artigo 11º	5,00%	8.276.899,62	0,53%	0,00%	0,00%	5,00%	69.634.376,43
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	468.346.233,72	30,06%	8,00%	32,00%	95,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	77.472.178,20	4,97%	1,00%	7,00%	10,00%	78.350.373,90
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	23.165.452,64	1,49%	1,00%	2,00%	10,00%	132.657.099,46
Total Exterior	10,00%	100.637.630,84	6,46%	2,00%	9,00%	20,00%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2023)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	491.491.340,24	31,54	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	170.473.332,85	10,94	0,04
CAIXA DTVM	162.023.854,33	10,40	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.080.256,56	9,70	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	64.028.422,94	4,11	4,17
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	57.432.970,35	3,69	0,01
ITAÚ UNIBANCO	56.708.922,87	3,64	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	55.460.189,56	3,56	0,18
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	43.224.077,36	2,77	0,03
ITAÚ DTVM	33.411.647,33	2,14	0,01
ICATU VANGUARDA	32.660.142,86	2,10	0,06
ARX INVESTIMENTOS	30.039.815,76	1,93	0,06
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	28.558.901,08	1,83	0,02
XP ASSET MANAGEMENT	24.059.916,01	1,54	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	21.153.722,92	1,36	0,01
MOAT CAPITAL	20.102.250,74	1,29	0,39
TARPON INVESTIMENTOS	17.570.975,04	1,13	0,30
VINCI PARTNERS	15.548.132,90	1,00	0,02
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	15.008.805,16	0,96	0,14
XP GESTÃO DE RECURSOS	14.532.976,26	0,93	0,00
OCCAM BRASIL	12.509.964,99	0,80	0,08
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	10.617.645,33	0,68	-
OLIVEIRA TRUST	10.597.674,37	0,68	0,11
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.356.426,65	0,34	0,07
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.700.000,00	0,30	0,01

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	491.491.340,24	31,54	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	341.666.786,30	21,93	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	145.407.470,27	9,33	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'a'	10.676.059,59	0,69	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	274.848.316,53	17,64	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	77.472.178,20	4,97	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	23.165.452,64	1,49	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	120.765.485,66	7,75	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	64.455.531,91	4,14	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	8.276.899,62	0,53	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	1,28%	3,56%	3,56%	7,18%	14,64%	23,45%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	-18,54%	-16,61%	-16,61%	-13,52%	-7,05%	1,37%	0,00%	0,00%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,49%	4,14%	4,14%	8,39%	17,24%	29,13%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	12,19%	-34,47%	-34,47%	241,06%	13.349.999.900,00%	274,79%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,52%	4,38%	4,38%	7,03%	10,38%	20,01%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,49%	4,32%	4,32%	6,87%	10,13%	19,36%	0,89%	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,50%	4,31%	4,31%	6,82%	9,96%	19,04%	0,89%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	4,32%	4,32%	6,89%	10,27%	19,62%	0,89%	0,02%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,51%	4,33%	4,33%	6,60%	9,92%	19,10%	0,90%	0,03%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,49%	4,32%	4,32%	6,91%	10,15%	19,50%	0,88%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	2,66%	3,98%	3,98%	4,22%	7,51%	12,36%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,60%	3,84%	3,84%	4,02%	7,07%	11,73%	1,60%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,71%	3,99%	3,99%	4,03%	7,17%	11,44%	1,64%	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,69%	3,85%	3,85%	3,79%	7,13%	11,69%	1,69%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,47%	3,71%	3,71%	3,55%	6,82%	11,18%	1,49%	0,04%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,64%	3,90%	3,90%	4,07%	7,24%	11,77%	1,61%	0,04%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2,12%	3,72%	3,72%	3,94%	8,13%	7,52%	1,28%	0,04%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)								
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,15%	3,89%	3,89%	5,70%	11,55%	13,99%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,12%	3,80%	3,80%	5,50%	11,28%	13,33%	1,33%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,12%	3,88%	3,88%	5,70%	11,40%	13,64%	1,33%	0,03%
	2,12%	3,82%	3,82%	5,56%	11,23%	13,35%	1,33%	0,03%
CDI (Benchmark)								
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1,13%	3,02%	3,02%	6,39%	13,33%	21,44%	0,03%	0,00%
	-	900,00%	900,00%	0,00%	0,00%	-	-	-
IPCA (Benchmark)								
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	2,09%	2,09%	3,76%	4,65%	16,48%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,88%	3,54%	3,54%	5,27%	10,69%	15,78%	0,88%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,21%	3,25%	3,25%	5,55%	11,71%	14,38%	0,19%	0,01%
	2,43%	4,12%	4,12%	3,57%	9,39%	16,97%	1,62%	0,03%
Não definido (Benchmark)								
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	-	-
	1,95%	-	-	-	-	-	2,93%	-

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,57%	3,32%	3,32%	4,20%	-	-	1,11%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	1,15%	3,12%	3,12%	-1,01%	4,04%	-58,76%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	-7,92%	-10,31%	-10,31%	-14,69%	-	-	-	-
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI (Benchmark)	1,17%	3,25%	3,25%	6,55%	13,28%	20,54%	-	-
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	0,59%	2,78%	2,78%	5,02%	11,27%	-	0,68%	0,02%
Ibovespa (Benchmark)	-2,91%	-7,16%	-7,16%	-7,41%	-15,10%	-12,65%	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,24%	-10,34%	-10,34%	-12,25%	-22,63%	-18,34%	8,56%	0,22%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,02%	-7,66%	-7,66%	-10,65%	-17,54%	-20,66%	5,71%	0,21%
BB AGRO FIC AÇÕES	-4,79%	-7,05%	-7,05%	-7,18%	-14,86%	-2,76%	7,50%	0,21%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,51%	-7,33%	-7,33%	-11,01%	-19,61%	-38,85%	9,69%	0,24%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MULTIMERCADO	-0,71%	-1,20%	-1,20%	-5,48%	-8,72%	-	2,80%	0,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MULTIMERCADO LP	0,41%	2,34%	2,34%	6,43%	-	-	2,98%	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,48%	-7,27%	-7,27%	-11,15%	-16,91%	-15,35%	9,24%	0,21%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,95%	-6,10%	-6,10%	-5,07%	-12,75%	-3,84%	7,70%	0,19%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-3,93%	-8,30%	-8,30%	-5,55%	-8,73%	-12,73%	8,21%	0,24%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,60%	-7,25%	-7,25%	-8,62%	-13,74%	-17,01%	8,67%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-5,07%	-10,05%	-10,05%	-18,77%	-26,61%	-29,77%	9,94%	0,25%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	-4,22%	-15,80%	-15,80%	-29,58%	-33,50%	-38,48%	14,20%	0,29%
OCCAM FIC AÇÕES	-2,80%	-6,55%	-6,55%	-8,01%	-12,63%	-12,41%	7,52%	0,20%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-0,29%	-1,06%	-1,06%	0,17%	0,58%	-	2,47%	0,07%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	1,97%	2,48%	2,48%	0,75%	-	-	4,00%	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-4,07%	-4,30%	-4,30%	-9,08%	-4,37%	22,71%	11,35%	0,26%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,37%	-6,69%	-6,69%	-12,38%	-19,78%	-20,53%	10,01%	0,23%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,29%	-3,01%	-3,01%	-7,27%	-2,77%	2,88%	7,71%	0,19%
IDIV (Benchmark)	-2,02%	-4,08%	-4,08%	-1,06%	-6,43%	4,48%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,50%	-4,43%	-4,43%	-4,31%	-10,37%	-4,59%	6,97%	0,17%
IFIX (Benchmark)	-1,69%	-3,70%	-3,70%	-7,68%	-0,68%	-3,01%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-1,63%	-13,27%	-13,27%	-19,73%	-31,79%	-44,65%	7,06%	0,23%
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	2,00%	5,72%	5,72%	11,21%	20,35%	54,04%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-1,88%	-22,28%	-22,28%	-36,89%	-94,05%	-95,49%	0,14%	0,87%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,25%	3,59%	3,59%	6,80%	10,93%	30,87%	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	17,06%	16,82%	16,82%	16,46%	-2,74%	72,09%	-	0,15%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	11,37%	11,02%	11,02%	7,74%	19,46%	-	-	0,18%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA...	-0,49%	-6,26%	-6,26%	-7,91%	-9,67%	-9,47%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,33%	3,84%	3,84%	7,30%	11,98%	33,35%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-7,08%	-24,10%	-24,10%	1,56%	26,47%	5,39%	11,89%	0,40%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,42%	4,08%	4,08%	7,79%	13,02%	35,86%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,74%	-1,82%	-1,82%	2,60%	-4,14%	16,54%	-	0,09%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,55%	4,44%	4,44%	8,53%	14,59%	39,66%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	46,26%	46,09%	46,09%	45,89%	32,30%	94,73%	72,89%	0,48%
S&P 500 (Benchmark)	3,51%	7,03%	7,03%	14,61%	-9,29%	3,43%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	4,14%	8,86%	8,86%	19,71%	3,14%	25,17%	8,66%	0,23%
SMLL (Benchmark)	-1,74%	-9,51%	-9,51%	-16,40%	-27,95%	-35,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,68%	-5,47%	-5,47%	-8,85%	-18,78%	-21,71%	4,79%	0,21%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-5,49%	-5,49%	-8,87%	-18,08%	-21,20%	4,74%	0,20%



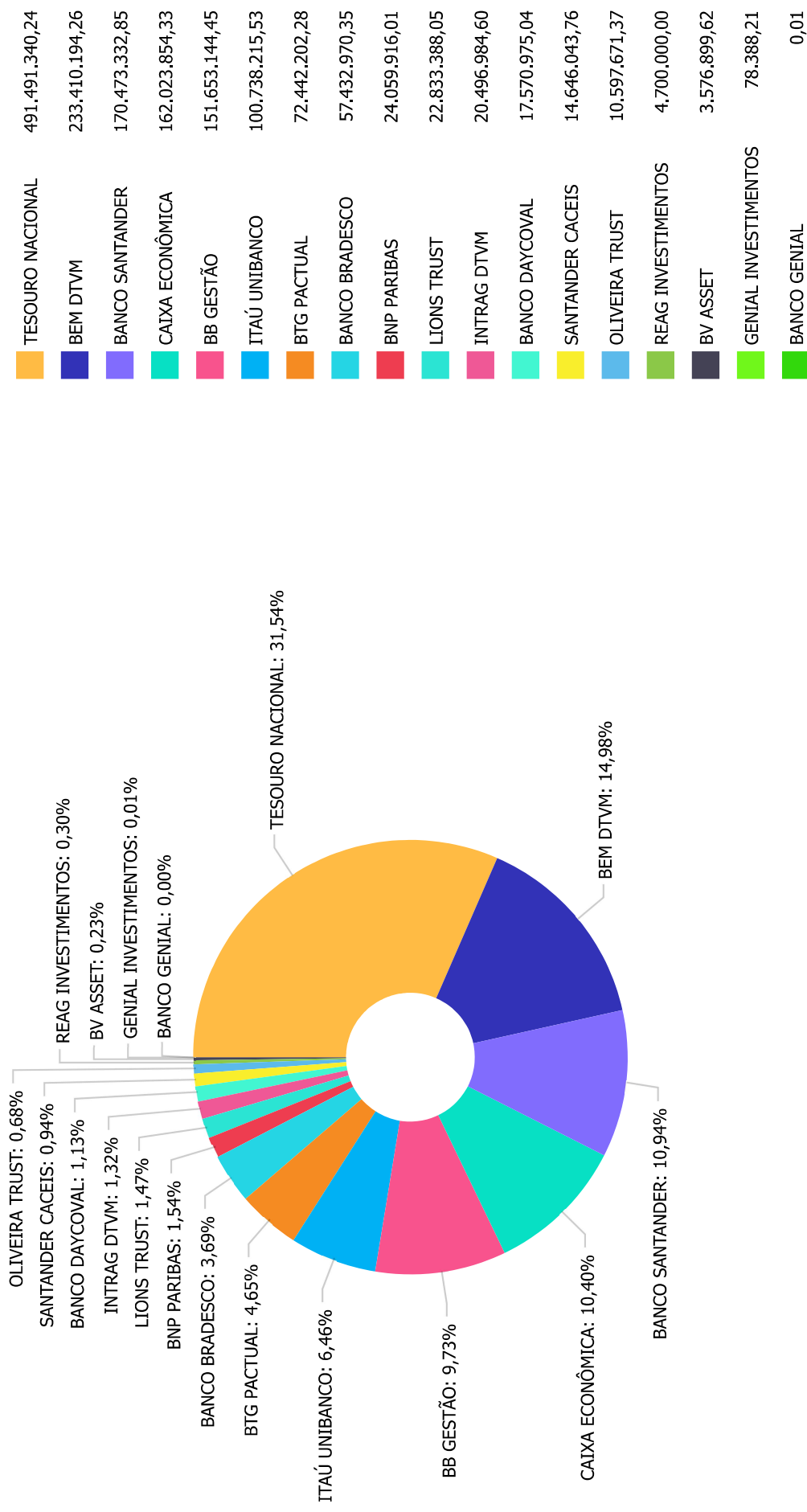
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

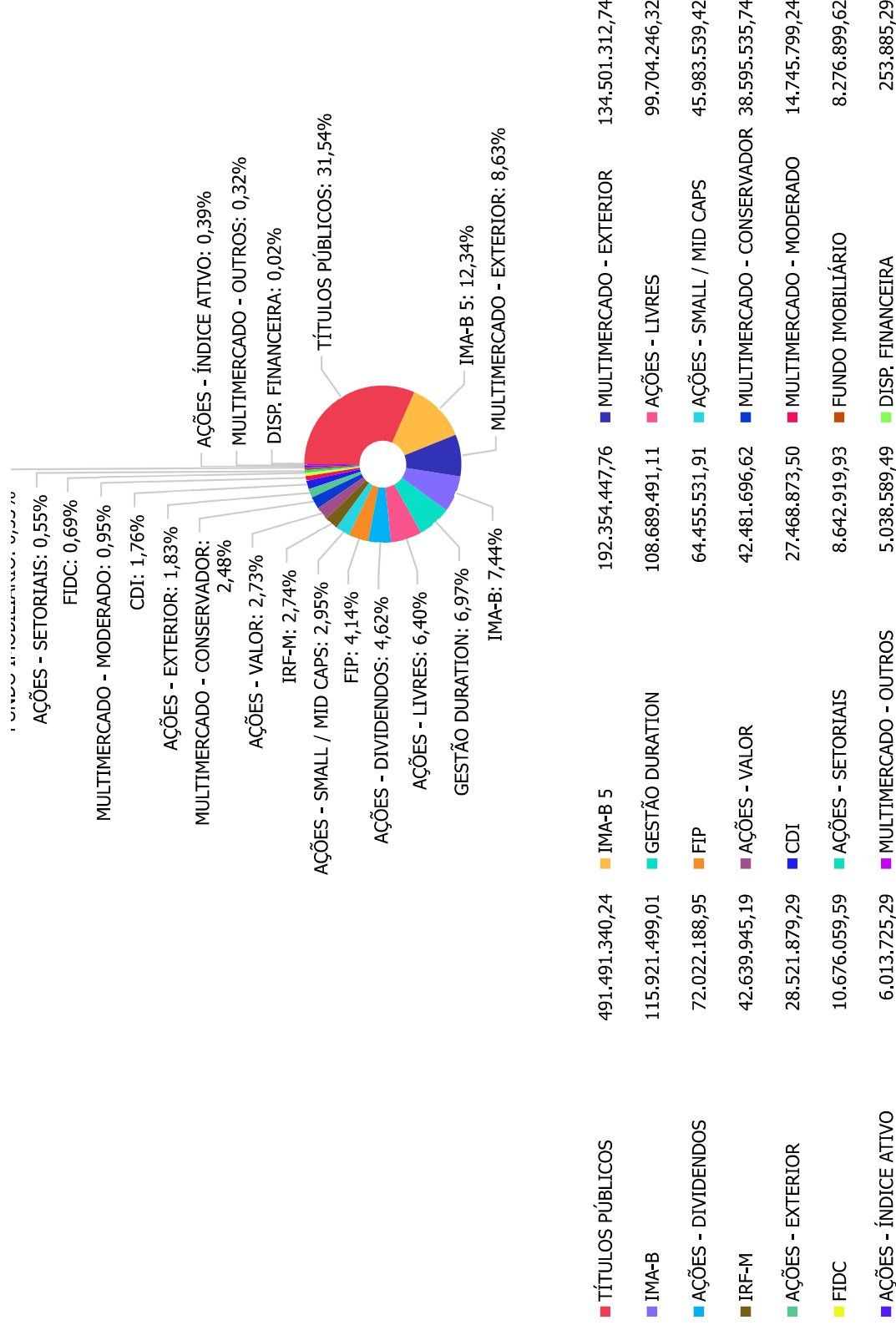
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,99%	8,73%	8,73%	13,01%	-3,04%	-8,03%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,66%	-2,31%	-	4,56%	-4,23%	-6,66%	7,25%	0,14%
MSCI WORLD (Benchmark)	0,32%	4,43%	4,43%	10,27%	-1,96%	-11,47%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-1,43%	0,90%	-	9,60%	-2,57%	-18,05%	6,12%	0,15%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,32%	4,83%	-	13,57%	2,48%	-3,12%	8,33%	0,15%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,30%	4,02%	4,02%	9,83%	-2,53%	-14,34%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,87%	2,99%	-	13,58%	0,45%	-9,85%	8,34%	0,16%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	-0,26%	0,02%	-	9,86%	-2,54%	-10,44%	8,08%	0,18%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULT...	-10,88%	-11,84%	-	-15,71%	4,63%	27,50%	14,47%	0,19%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	-13,78%	-16,37%	-	-22,40%	3,34%	-	12,33%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIM...	-0,36%	4,51%	-	-	-	-	8,16%	-





CRÉDITO & MERCADO

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2023)





**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2023)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SÃO BERNARDO DO CAMPO - SBCPREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2023

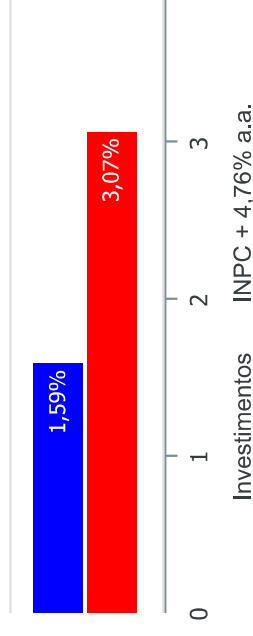
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	4.175,103533	5.186.681,53	8.350.207,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	31/05/2021	7.600	3825,999376	4.175,103533	29.077.595,26	31.730.786,85	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.142,883396	10.048.181,87	14.085.803,55	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2027	13/12/2022	12.000	3959,170000	4.212,882806	47.510.040,00	50.554.593,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.136,095699	14.651.394,86	14.269.530,16	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.136,095699	7.520.551,00	13.235.506,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.136,095699	13.087.396,08	16.544.382,80	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.136,095699	25.480.686,71	24.816.574,19	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.136,095699	36.097.639,50	35.156.813,44	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.136,095699	55.208.154,53	53.769.244,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.040,039367	24.699.419,65	24.240.236,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.040,039367	20.000.340,99	19.897.193,88	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.040,039367	20.609.488,43	20.503.199,79	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.040,039367	25.008.464,96	25.048.244,08	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.060,904497	25.347.747,49	24.365.426,98	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.060,904497	41.512.279,91	40.609.044,97	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.060,904497	25.038.468,13	25.583.698,33	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/04/2022	12.000	4159,261023	4.060,904497	49.911.132,28	48.730.853,96	Mercado



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

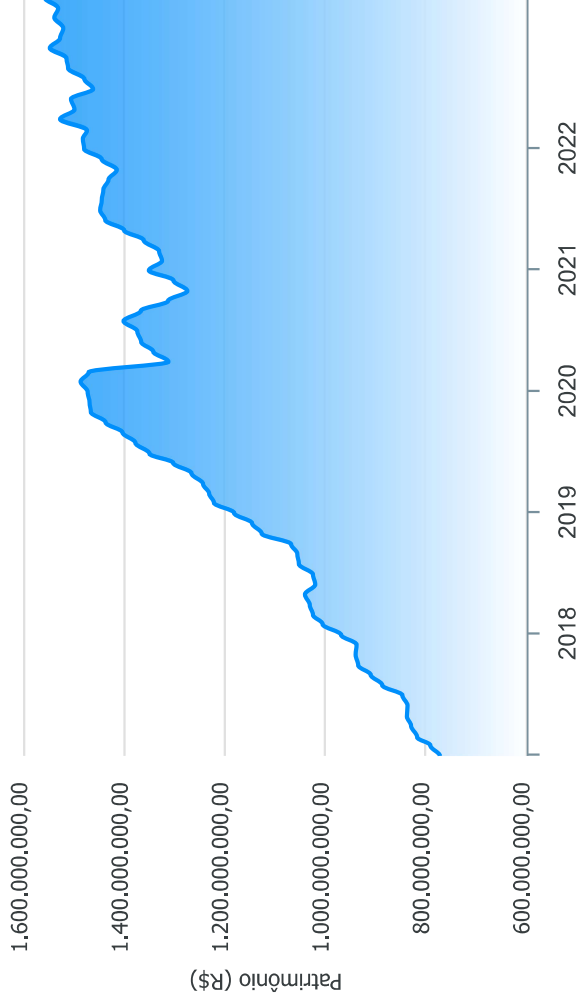
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.521.923,415,51	19.745,851,98	15.034,568,84	1.539.330,940,80	12.696,242,15	12.696,242,15	0,83%	0,83%	0,87%	0,87%	95,74%	5,49%
Fevereiro	1.539.330,940,80	164.546,755,80	162.749,949,62	1.532.011,715,31	-9.116,031,67	3.580,210,48	-0,59%	0,24%	1,11%	1,98%	11,86%	4,56%
Março	1.532.011,715,31	42.891,324,38	37.407,841,36	1.558.225,520,96	20.730,322,63	24.310,533,11	1,35%	1,59%	1,07%	3,07%	51,64%	4,33%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMILL IDIV

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2023****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	69.867,49	0,00	19.923,69	78.388,21	28.444,41	40,71%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	475.375.186,35	0,00	0,00	491.491.340,24	16.116.153,89	3,39%	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.859.593,53	0,00	0,00	21.424.434,29	564.840,76	2,71%	2,71%	1,64%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	16.130.149,78	0,00	0,00	16.564.001,49	433.851,71	2,69%	2,69%	1,69%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	39.983.698,28	0,00	0,00	41.038.498,85	1.054.800,57	2,64%	2,64%	1,61%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.811.679,18	0,00	0,00	15.197.029,61	385.350,43	2,60%	2,60%	1,60%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.680.144,24	0,00	0,00	2.746.380,49	66.236,25	2,47%	2,47%	1,49%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.365.330,44	0,00	0,00	10.617.645,33	252.314,89	2,43%	2,43%	1,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.506.715,33	0,00	0,00	15.835.868,26	329.152,93	2,12%	2,12%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.231.563,48	0,00	0,00	13.512.385,08	280.821,60	2,12%	2,12%	1,33%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.016.296,92	0,00	0,00	13.291.691,85	275.394,93	2,12%	2,12%	1,33%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.496.625,38	0,00	0,00	3.570.584,78	73.959,40	2,12%	2,12%	1,28%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	15.086.284,50	0,00	0,00	15.380.569,50	294.285,00	1,95%	1,95%	2,93%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	64.775.753,40	0,00	0,00	65.991.211,49	1.215.458,09	1,88%	1,88%	0,88%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	32.173.300,35	0,00	0,00	32.660.142,86	486.842,51	1,51%	1,51%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	37.098.478,33	0,00	0,00	37.654.108,46	555.630,13	1,50%	1,50%	0,89%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	35.478.188,73	0,00	0,00	36.008.536,06	530.347,33	1,49%	1,49%	0,89%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	72.731.648,44	0,00	0,00	73.815.239,73	1.083.591,29	1,49%	1,49%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.037.333,02	0,00	0,00	12.216.420,65	179.087,63	1,49%	1,49%	0,89%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.455.714,06	0,00	0,00	10.597.671,37	141.957,31	1,36%	1,36%	0,00%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	31.696.361,53	0,00	0,00	32.080.634,29	384.272,76	1,21%	1,21%	0,19%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	22.083.626,55	13.700.000,00	8.650.000,00	27.468.873,50	335.246,95	0,94%	1,13%	0,03%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÉN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	959.143.539,32	13.700.000,00	8.669.923,69	989.241.656,40	25.068.040,77	2,60%		1,04%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.419.629,07	0,00	8.381.617,78	0,00	-38.011,29	-0,45%	-3,20%	8,21%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3.637.342,10	0,00	34.538,56	3.576.899,62	-25.903,92	-0,71%	-1,63%	7,06%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.280.258,95	8.380.000,00	0,00	14.532.976,26	-127.282,69	-0,87%	-1,29%	7,71%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.242.244,42	0,00	0,00	14.029.168,55	-213.075,87	-1,50%	-1,50%	6,97%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	38.791.085,67	0,00	0,00	37.751.843,81	-1.039.241,86	-2,68%	-2,68%	4,79%
OCCAM FIC AÇÕES	12.870.069,02	0,00	0,00	12.509.964,99	-360.104,03	-2,80%	-2,80%	7,52%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.827.561,21	0,00	0,00	13.420.228,38	-407.332,83	-2,95%	-2,95%	7,70%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.483.787,52	0,00	0,00	8.231.695,61	-252.091,91	-2,97%	-2,97%	4,74%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	31.044.856,92	0,00	0,00	30.039.815,76	-1.005.041,16	-3,24%	-3,24%	8,56%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.572.886,21	0,00	0,00	3.452.511,87	-120.374,34	-3,37%	-3,37%	10,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	31.051.015,31	0,00	0,00	29.971.731,63	-1.079.283,68	-3,48%	-3,48%	9,24%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.900.000,00	0,00	26.000,00	4.700.000,00	-174.000,00	-3,55%	-7,08%	11,89%
ITAÚ FOF RPI IBOVSPA ATIVO FIC AÇÕES	6.238.386,13	0,00	0,00	6.013.725,29	-224.660,84	-3,60%	-3,60%	8,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.518.384,96	0,00	0,00	27.397.922,04	-1.120.462,92	-3,93%	-3,93%	8,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9.873.483,40	0,00	0,00	9.476.650,14	-396.833,26	-4,02%	-4,02%	5,71%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	18.317.311,57	0,00	0,00	17.570.975,04	-746.336,53	-4,07%	-4,07%	11,35%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	20.988.056,54	0,00	0,00	20.102.250,74	-885.805,80	-4,22%	-4,22%	14,20%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.077.866,78	0,00	0,00	8.642.919,93	-434.946,85	-4,79%	-4,79%	7,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	21.197.403,89	0,00	0,00	20.123.241,85	-1.074.162,04	-5,07%	-5,07%	9,94%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.672.936,61	0,00	0,00	1.580.694,64	-92.241,97	-5,51%	-5,51%	9,69%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Março/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	293.004.566,28	8.380.000,00	8.442.156,34	283.125.216,15	-9.817.193,79	-3,26%		8,38%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Março / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	19.814.175,52	0,00	20.295.761,33	0,00	481.585,81	2,43%	2,41%	11,95%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.309.993,21	0,00	0,00	5.356.426,65	46.433,44	0,87%	0,87%	8,34%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	0,00	10.145.000,00	0,00	10.144.309,07	-690,93	-0,01%	-10,88%	14,47%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.198.200,61	0,00	0,00	4.187.232,29	-10.968,32	-0,26%	-0,26%	8,08%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	20.260.451,69	0,00	0,00	20.195.922,38	-64.529,31	-0,32%	-0,32%	8,33%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	13.047.953,86	0,00	0,00	13.000.884,24	-47.069,62	-0,36%	-0,36%	8,16%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.074.949,06	0,00	0,00	14.859.028,92	-215.920,14	-1,43%	-1,43%	6,12%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	23.557.506,24	0,00	0,00	23.165.452,64	-392.053,60	-1,66%	-1,66%	7,25%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	0,00	10.145.000,00	0,00	9.728.374,65	-416.625,35	-4,11%	-13,78%	12,33%
Total Exterior	101.263.230,19	20.290.000,00	20.295.761,33	100.637.630,84	-619.838,02	-0,51%		8,73%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	477.675.700,98	0,00	3.050.650,97	491.491.340,24	16.866.290,23	3,53%	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	60.630.930,42	10.302.693,85	0,00	73.815.239,73	2.881.615,46	4,06%	4,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	63.736.390,80	0,00	0,00	65.991.211,49	2.254.820,69	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.876.322,12	219.416,68	0,00	37.654.108,46	1.558.369,66	4,32%	4,32%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	39.498.842,35	0,00	0,00	41.038.498,85	1.539.656,50	3,90%	3,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	34.521.711,48	0,00	0,00	36.008.536,06	1.486.824,58	4,31%	4,31%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	31.303.399,60	0,00	0,00	32.660.142,86	1.356.743,26	4,33%	4,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	31.071.561,11	0,00	0,00	32.080.634,29	1.009.073,18	3,25%	3,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.601.906,00	0,00	0,00	21.424.434,29	822.528,29	3,99%	3,99%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	8.544.126,30	93.518.509,23	75.287.207,01	27.468.873,50	693.444,98	0,68%	3,02%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.949.675,89	0,00	0,00	16.564.001,49	614.325,60	3,85%	3,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.255.698,72	0,00	0,00	15.835.868,26	580.169,54	3,80%	3,80%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.635.543,04	0,00	0,00	15.197.029,61	561.486,57	3,84%	3,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.710.282,83	0,00	0,00	12.216.420,65	506.137,82	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.008.193,16	0,00	0,00	13.512.385,08	504.191,92	3,88%	3,88%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.802.615,73	0,00	0,00	13.291.691,85	489.076,12	3,82%	3,82%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.197.140,58	0,00	0,00	10.617.645,33	420.504,75	4,12%	4,12%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR 1	10.213.346,01	0,00	0,00	10.597.671,37	384.325,36	3,76%	-16,61%
RIO BRAVO ESTRATÉGICO IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	15.000.000,00	0,00	15.380.569,50	380.569,50	2,54%	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	10.408.177,72	0,00	7.000.000,00	3.570.584,78	162.407,06	1,56%	3,72%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insttit
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.181.469,44	0,00	10.302.693,85	0,00	121.224,41	1,19%	4,06%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	11.595.646,39	0,00	11.712.858,26	0,00	117.211,87	1,01%	4,06%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.648.082,53	0,00	0,00	2.746.380,49	98.297,96	3,71%	3,71%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	119.643,27	0,00	103.989,68	78.388,21	62.734,62	52,43%	-34,47%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	900,00%
Total Renda Fixa	942.186.406,48	119.040.619,76	107.457.399,77	989.241.656,40	35.472.029,93	3,72%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	37.483.286,25	0,00	40.863.027,95	0,00	3.379.741,70	9,02%	8,78%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	17.609.165,00	0,00	0,00	20.571.491,99	2.962.326,99	16,82%	16,82%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTR...	7.092.679,25	0,00	0,00	7.874.341,59	781.662,34	11,02%	11,02%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	40.863.027,95	0,00	41.643.382,72	780.354,77	1,91%	8,86%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	20.075.694,02	0,00	0,00	20.742.178,47	666.484,45	3,32%	3,32%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	14.389.221,46	0,00	0,00	14.745.799,24	356.577,78	2,48%	2,48%
MAG STRATEGY FI MULTIMERCADO	11.930.801,05	0,00	0,00	12.262.424,67	331.623,62	2,78%	2,78%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	392.158,01	0,00	0,00	572.887,89	180.729,88	46,09%	46,09%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	4.923.590,74	0,00	0,00	5.038.589,49	114.998,75	2,34%	2,34%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULTIESTRATÉGIA	598.749,97	74.906,75	0,00	772.291,34	98.634,62	14,64%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.011.592,35	0,00	0,00	2.074.398,99	62.806,64	3,12%	3,12%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	10.794.266,49	521.324,38	0,00	11.323.329,69	7.738,82	0,07%	-1,81%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	145.481,58	0,00	22.808,87	113.067,50	-9.605,21	-6,60%	-22,28%
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ...	417.218,15	26.435,30	0,00	394.733,86	-48.919,59	-11,03%	-10,31%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.705.799,89	0,00	0,00	1.580.694,64	-125.105,25	-7,33%	-7,33%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	13.300.366,08	0,00	0,00	13.159.875,73	-140.490,35	-1,06%	-1,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	13.332.537,27	0,00	0,00	13.173.235,34	-159.301,93	-1,19%	-1,19%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.391.999,13	8.380.000,00	0,00	14.532.976,26	-239.022,87	-1,62%	-3,01%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.700.056,27	0,00	0,00	3.452.511,87	-247.544,40	-6,69%	-6,69%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.751.746,57	0,00	8.381.617,78	0,00	-370.128,79	-4,23%	-6,87%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.125.199,26	0,00	101.457,02	3.576.899,62	-446.842,62	-10,83%	-13,27%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.483.463,42	0,00	0,00	6.013.725,29	-469.738,13	-7,25%	-7,25%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.709.472,47	0,00	0,00	8.231.695,61	-477.776,86	-5,49%	-5,49%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.679.280,65	0,00	0,00	14.029.168,55	-650.112,10	-4,43%	-4,43%
BB AGRO FIC AÇÕES	9.298.102,04	0,00	0,00	8.642.919,93	-655.182,11	-7,05%	-7,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.263.201,85	0,00	0,00	9.476.650,14	-786.551,71	-7,66%	-7,66%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	18.361.146,73	0,00	0,00	17.570.975,04	-790.171,69	-4,30%	-4,30%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.291.691,03	0,00	0,00	13.420.228,38	-871.462,65	-6,10%	-6,10%
OCCAM FIC AÇÕES	13.387.073,56	0,00	0,00	12.509.964,99	-877.108,57	-6,55%	-6,55%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.999.000,00	0,00	78.000,00	4.700.000,00	-1.221.000,00	-20,35%	-24,10%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	22.144.668,03	0,00	0,00	20.758.989,06	-1.385.678,97	-6,26%	-6,26%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	39.934.448,43	0,00	0,00	37.751.843,81	-2.182.604,62	-5,47%	-5,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	22.372.255,95	0,00	0,00	20.123.241,85	-2.249.014,10	-10,05%	-10,05%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	32.321.389,25	0,00	0,00	29.971.731,63	-2.349.657,62	-7,27%	-7,27%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.876.967,90	0,00	0,00	27.397.922,04	-2.479.045,86	-8,30%	-8,30%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.505.528,92	0,00	0,00	30.039.815,76	-3.465.713,16	-10,34%	-10,34%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	23.873.300,99	0,00	0,00	20.102.250,74	-3.771.050,25	-15,80%	-15,80%
Total Renda Variável	484.672.600,01	49.865.694,38	49.446.911,62	468.346.233,72	-16.745.149,05	-3,45%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insttit
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	17.604.894,38	0,00	20.295.761,33	0,00	2.690.866,95	15,28%	15,26%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.203.517,42	0,00	24.604.669,08	0,00	2.401.151,66	10,81%	11,94%
FRANKLIN CLEARBRIDGE AÇÕES EUA GROWTH INVESTIMENTO...	11.877.728,42	0,00	13.387.618,02	0,00	1.509.889,60	12,71%	16,46%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	19.264.837,90	0,00	0,00	20.195.922,38	931.084,48	4,83%	4,83%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	5.200.847,61	0,00	0,00	5.356.426,65	155.579,04	2,99%	2,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.726.042,30	0,00	0,00	14.859.028,92	132.986,62	0,90%	0,90%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	4.186.540,99	0,00	0,00	4.187.232,29	691,30	0,02%	0,02%
SYSTEMATICA BLUE TREND ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	0,00	10.145.000,00	0,00	10.144.309,07	-690,93	-0,01%	-11,84%
BB GLOBAL SELECT EQUITY VALUE INVESTIMENTO NO EXTE...	0,00	13.387.618,02	0,00	13.000.884,24	-386.733,78	-2,89%	4,51%
SYSTEMATICA BLUE TREND DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	0,00	10.145.000,00	0,00	9.728.374,65	-416.625,35	-4,11%	-16,37%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	24.600.000,00	0,00	23.165.452,64	-1.434.547,36	-5,83%	-2,31%
Total Exterior	95.064.409,02	58.277.618,02	58.288.048,43	100.637.630,84	5.583.652,23	3,64%	



Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022, e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.